
INSTRUKTION GÄLLANDE JÄMFÖRELSEINDEX

OPTIMIZED PORTFOLIO MANAGEMENT STOCKHOLM AB

Fastställd av	VD
Datum	1 februari 2019
Senast antagen	N/A
Fastställs	Årligen
Kontakt	VD

1. Inledning

I lagrådsremissen ”Aktivitetsgrad i fondförvaltning” föreslås att det ska införas krav på att information om aktivitetsgrad i fondförvaltningen ska lämnas. Förslaget innebär att det i lag ställs upp krav på att fondbolag och AIF-förvaltare, för värdepappersfonder och specialfonder vars förvaltning kan jämföras med ett relevant jämförelseindex, ska lämna information om aktivitetsgraden i fondförvaltningen i förhållande till jämförelseindexet. Informationen ska även beskriva hur förvaltningen av fonden bedrivs och varför det jämförelseindex som används är relevant.

Ett index är ett relevant jämförelseindex för en fond om indexet ger en god representation av fondens strategiska investeringsinriktning med avseende på val av tillgångsslag eller marknad (bransch och/eller geografi) eller med avseende på avkastnings- och riskprofil generellt.

Om fonden har funnits i två år eller längre tid ska aktivitetsgraden även anges som aktiv risk (Tracking Error), det vill säga volatiliteten i skillnaden mellan fondens avkastning och jämförelseindexets avkastning. Gällande Bolagets fonder som endast investerar med aktier, och som har ett relevant jämförelseindex skall även aktivitetsgraden i termer av Active Share anges.

2. Omfattning

Instruktionen omfattar samtliga av Bolaget förvaltade UCITS-fonder och specialfonder.

3. Governance

Instruktionen fastställs av VD som tillika är ansvarig för att instruktionen tillämpas samt att instruktionen uppdateras vid behov, dock minst årligen.

4. Fonder och dess jämförelseindex

4.1 Carneo Systematic Alpha

HFRX Macro/CTA Index - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

4.2 OPM Absolute Managers

HFRX Global Hedge Fund Index - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

4.3 OPM Global Quality Companies

Morningstar Global Markets NR USD (i SEK) - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

4.4 OPM Listed Private Equity

Red Rocks Capital Global Listed Private Equity Index - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

4.5 OPM Multi Hedge

HFRX Global Hedge Fund Index - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

4.6 OPM Vega

HFRX Global Hedge Fund Index - Valt jämförelseindex bedöms vara relevant då det väl överensstämmer med fondens placeringsinriktning.

.